

DAFTAR PUSTAKA

- Analia, 2015. Studi Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap Return Saham pada BEI: Pengujian Week Four Effect dan Rogalsky Effect . Skripsi, Januari 2015.
- Alteza, Muniya. 2007. “Efek Hari Perdagangan Terhadap Return Saham: Suatu Telaah atas Anomali Pasar Efisien”. *Jurnal Ilmu Manajemen*, Vol. 3, No. 1, hal. 31-43.
- Ambarwati, Sri Dwi Ari. 2009. “Pengujian Week-Four, Monday, Friday dan Earnings Management Effect Terhadap Return Saham”. *Jurnal Keuangan dan Perbankan*, Vol. 13, No. 1, hal. 1-14.
- Anoraga, Pandji dan Piji Pakarti. 2006. *Pengantar Pasar Modal*. Rineka Cipta: Jakarta
- Cahyaningdyah, D. 2005. Analisis Pengaruh Hari Perdagangan terhadap Return Saham. *Jurnal Ekonomi dan Bisnis Indonesia*, 20 (2): 175-186.
- Fama, E.F. 1991. Efficient Capital Market: a Review of Theory and Empirical Work. *Journal of Finance*, 25: 387-417.
- Fakhrudin, M. dan M. Sopian Hadianto. 2001. *Perangkat dan Model Analisis Investasi di Pasar Modal*. Elex Media Komputindo: Jakarta.
- Gumanti, Tatang Ary dan Elok Sri Utami. 2002. “Bentuk Pasar Efisien dan Pengujiannya”. *Jurnal Akuntansi dan Keuangan*, Vol. 4, No. 1, hal. 54-68.
- Ghozali, Imam. 2006. Statistik Non-parametrik Teori dan Aplikasi dengan Program SPSS. UNDIP : Semarang
- Hasan, I. 2010. Analisis Data Penelitian dengan Statistik. Grafika: Jakarta
- Iramani, Rr. dan Ansyori Mahdi. 2006. “Studi Tentang Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap Return Saham pada BEJ”. *Jurnal Akuntansi dan Keuangan*, Vol. 8, No.2, hal. 63-70.
- Jogiyanto. 2003. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. BPFE: Yogyakarta.
- Karina Maliasari. 2012. Pengaruh *January Effect* dan *Rogalski Effect* Terhadap Abnormal Return Saham Dan Trading Volume Activity (Studi Pada Perusahaan LQ45 yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia).
- Kuncoro, M. 2004. Metode Kuantitatif Teori dan Aplikasi untuk Bisnis dan Ekonomi. Ed. Kedua. AMP YKPN: Yogyakarta
- Khajar, Ibnu. 2008. “Pengujian Efisiensi dan Peningkatan Efisiensi Bentuk Lemah Bursa Efek Indonesia Pada Saat dan Sesudah Krisis Moneter Pada Saham-

saham LQ-45". *Jurnal Manajemen Teori dan Terapan*, Tahun 1, No.2, hal. 144-164.

Lutfiaji. 2010. Pengujian *The Day Of The Week Effect, Week Four Effect, Dan Rogalsky Effect* Terhadap Return Saham LQ-45 Di Bursa Efek Indonesia.

Mamduh, Syafiq. 2012. Perbandingan Kinerja Investasi Syariah Dan Konvensional: Studi Pada Jakarta Islamic Index (JII) Dan Indeks LQ45. *EKBISI*, Vol. VII, No. 1, Desember 2012, Hal. 16-27. ISSN:1907-9109.

Mario Rita. 2009. Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap *Return Saham: Pengujian Day of the Week Effect, Week-Four Effect dan Rogalski Effect* di BEI. *Jurnal Ekonomi dan Bisnis* Vol. XV No.2 September 2009: 121-134.

Mellysa, Syahyunan. 2012. Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap Return Saham LQ-45 Di Bursa Efek Indonesia.

Misbahuddin dan Iqbal Hasan. 2013. Analisis Data Penelitian dengan Statistik. Edisi Kedua. Bumi Aksara: Jakarta

Muniya Alteza, 2006, Efek Hari Perdagangan Terhadap Return Saham Suatu Telaah atas Anomali Pasar Efisien, *Jurnal Ilmu Manajemen*, Program Studi Manajemen, Universitas Negeri, Yogyakarta

Rr. Iramani, Ansyori Mahdi. 2006. Studi Tentang Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap *Return Saham* pada BEJ. *Jurnal Akuntansi dan Keuangan*, vol. 8, no. 2, Nopember 2006: 63-70.

Riduwan, dan Sunarto. 2011. Pengantar Statistika untuk Penelitian Pendidikan, Sosial, Ekonomi, Komunikasi, dan Bisnis. Bandung: Alfabeta.

Robiyanto. 2000. "Pengaruh Hari Perdagangan Saham Terhadap Return Harian Saham di Bursa Efek Jakarta (Sebuah Studi Terhadap IHSG, Indeks Saham Sektorial dan Indeks Saham Unggulan (LQ-45))". *Tesis*. Universitas Diponegoro.

Sinarti, Ainun Na'im. 2010. Kinerja Akuntansi dan Kinerja Pasar Modal pada Perusahaan dalam *Jakarta Islamic Index*.

Situmorang, Syahfrizal Helmi, Iskandar Muda, Doli M. Ja'far Dalimunthe, Fadli dan Fauzie Syarief. 2010. *Analisis Data untuk Riset Manajemen dan Bisnis*. USU Press: Medan.

Sudarmanto, R. Gunawan. 2005. *Analisis Regresi Linear Ganda dengan SPSS*. Graha Ilmu: Jakarta.

Sulaiman, Wahid. 2002. *Jalan Pintas Menguasai SPSS 10*. Andi: Yogyakarta.

Supriyono, Edi dan Wibi Wibowo. 2008. "Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap Return Saham: Pengujian Week-four Effect di Bursa Efek Jakarta". *Jurnal Manajemen dan Bisnis*, Vol. 16, No. 1, hal. 54-62.

- Shinta. 2011. "Analisis fenomena the day of the week effect: Pengujian Monday Effect, Week Four Effect dan Rogalsky Effect (studi empiris pada perusahaan LQ45 di BEI)". *Jurnal Manajemen*, Vol. 10, No. 2, Mei 2011.
- Sri Dwi Ari Ambarwati, 2009. Pengujian Week-Four, Monday, Friday dan Earnings Management Effect Terhadap Return Saham. *Jurnal Keuangan dan Perbankan*, Vol. 13 No.1, hal 1-14.
- Tandelilin, Eduardus. 2010. **Portofolio dan Investasi**. Kanisius. Yogyakarta.
- Wang, K., Y. Li, J. Erickson. 1997. A New Look At The Monday Effect. *Journal of Finance*, LII (5): 2171-2186.
- Wihandaru. 2004. Pengaruh Hari Perdagangan Saham Terhadap Indeks Harga Saham (Studi Kasus pada IHSG dan Indeks LQ45 Tahun 2000). *Utilitas*, 12 (1) Januari: 73-89.
- Wong, K.A., and K. Yuanto. 1999. Short Term Seasonalities on the Jakarta Stock Exchang. *Pasific Basin Financial Market and Policies*, 2 (3): 375-398.
- www.idx.co.id dan finance.yahoo.com diakses oleh Arum ambarwaty 20 Maret 2016.
- www.statistikian.com diakses Arum Ambarwaty 22 Maret 2016.